

EAバックテスト監査報告書

【フル監査】

サンプル版

お客様のEA監査のご検討用に、実際のテスターレポートを用いて作成した見本です

対象EA	LonerWave3_EA_v1.0
通貨ペア / 時間足	USDJPY / 5分足(M5)
テスト期間	2017.01.02 - 2026.08.20
監査データ	ストラテジーテスター報告書 (XMTradingMU-Real 262 (Build 1476))
総合判定	【 要フォワード 】
報告書作成	rehav

売買ルールを全て取り出し、本物の価格データで再検証した上で、統計的な有意性まで確認します。

本サンプルはご依頼者ご自身のEAのテスターレポートに基づいて作成しています。EAのファイル・設定・成績は実監査の場合、納品から30日後に完全消去します。

1. 監査対象の概要

通貨ペア	USDJPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間	2017.01.02 - 2026.08.20 (テストバー数 718,737 / モデルティック数 182,661,439)
モデル	全ティック / モデリング品質 90.00% / 不整合チャートエラー 0
初期証拠金	10,000.00 スプレッド : 10ポイント (固定) = 1.0pip
純益	791.32 (総利益 934.47 / 総損失 -143.15)
プロフィットファクター	6.53 / 期待利得 22.61
ドロウダウン	絶対 61.48 / 最大 203.52 (2.01%)
取引数	35 (買い25 / 売り10) / 34勝1敗 (勝率97.14%)
連勝・連敗	最大28連勝 (+812.73) / 最大連敗 1 (-143.15)

9.6年間で35トレード、勝率97.14%、PF 6.53という高勝率型の成績です。一見極めて優秀ですが、勝率が高いほど「数字の見せ方」による粉飾が通用しやすいため、本監査では設定条件と構造の健全性を重点的に確認します。

2. EAのルール構造（テスター設定パラメータから抽出）

本サンプルでは提出されたテスター報告書の入力パラメータから、以下のロジック構造を抽出しました。

トレンドゲート	H1足の移動平均 (TrendMA_Period=40) で上位足の方向を規定。UseH1=true (H4/D1は無効)
波動回避ゲート	WaveAvoidMA (80) + スイングATR (14期間 × 2.5倍) で乱高下ゾーンを回避 (UseWaveAvoidGate=true)
押し・戻り条件	ABゾーン (MinAB_Bars=30、MinAB_ATR_Mult=5、MaxZone=2) で調整の深さを規定
決済構造	TPIはATR比0.5倍 (最小50ポイント = 5pips)、SLはATRベース + 5ポイントバッファ (最小30 pips)
リスク管理	リスク1%/トレード (RiskPercent=1)、最大5ロット、エントリー時最大スプレッド40ポイント
フィルタ	上位足の期限 (H1:100本/H4:60本/D1:30本)、保有日数上限 (H4:7日/D1:30日)、通貨相関ゲート

構造診断：6層のゲートでエントリーを絞り込む「時間軸フィルタ型」です。9.6年で35トレード（年3.7件）という超低頻度はこのフィルタ構造の直接的な結果です。パラメータ総数は約30個で、サンプル35トレードに対して自由度比（パラメータ数/トレード数）が約0.86と極めて高く、過剰最適化（カーブフィット）のリスクが構造的に高い設計です。

3. 統計検証（テスター成績の有意性）

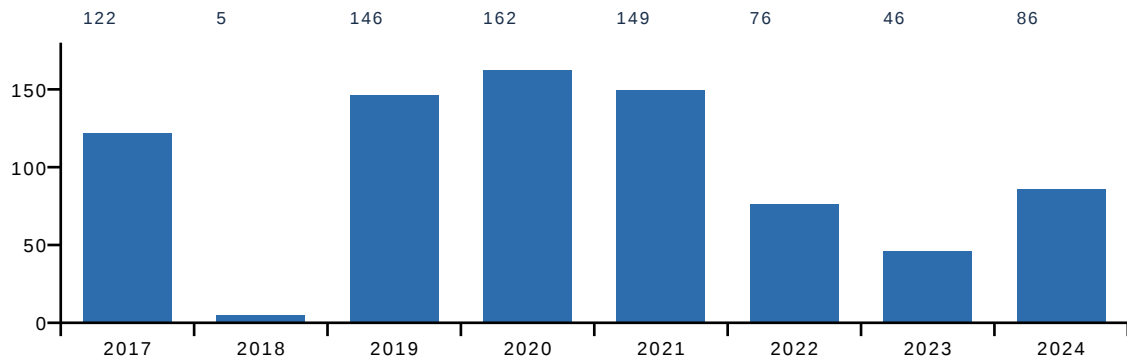
1トレード期待値	\$22.61 (標準偏差\$30.58)
t値	4.37 (p < 0.001) テスター上の数値としては統計的に有意
勝率の95%信頼区間	85.5% ~ 99.5% (Wilson区間。35トレードの制約)
損益分岐勝率	83.9% (平均勝ち\$27.48 / 平均負け\$143.15)
エッジの厚み	観測勝率97.1% - 分岐勝率83.9% = 13.2ポイント。ただし信頼下限85.5%では1.6ポイントまで縮む

要旨：テスター上では期待値は統計的に有意 (t=4.37) です。しかし取引数35件は少なく、勝率の信頼下限 (85.5%) は損益分岐勝率 (83.9%) をわずかに上回るのみです。「統計的に壊れてはいないが、エッジは薄い」——これが本EAの正確な位置づけです。

残高推移（初期証拠金\$10,000 → 最終\$10,791）



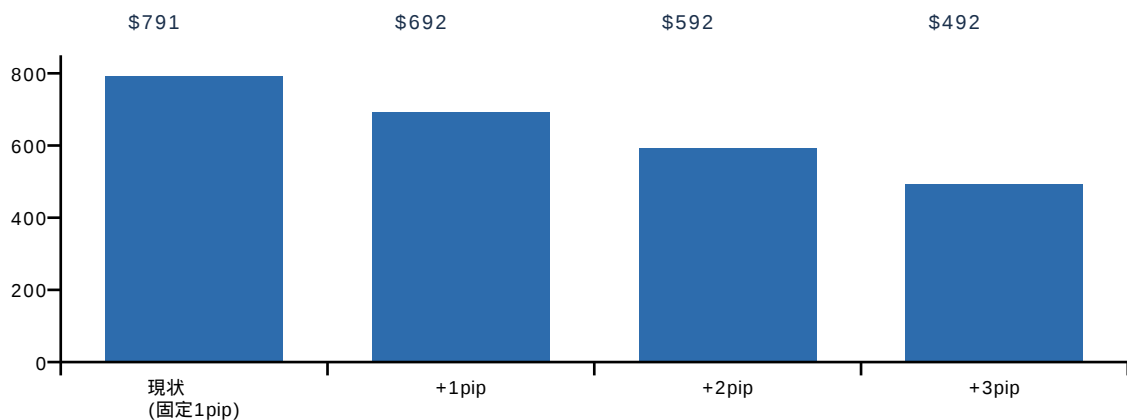
▲ 残高推移。右端の赤四角は唯一の損切り（2018.03、-\$143.15）。以降28連勝で回復。



▲ 年別損益（\$）。年3～6件、\$5～\$162/年のペース。総額\$791を9.6年で稼ぐ構造で、年率リターンは約0.8%。

4. ストレステスト

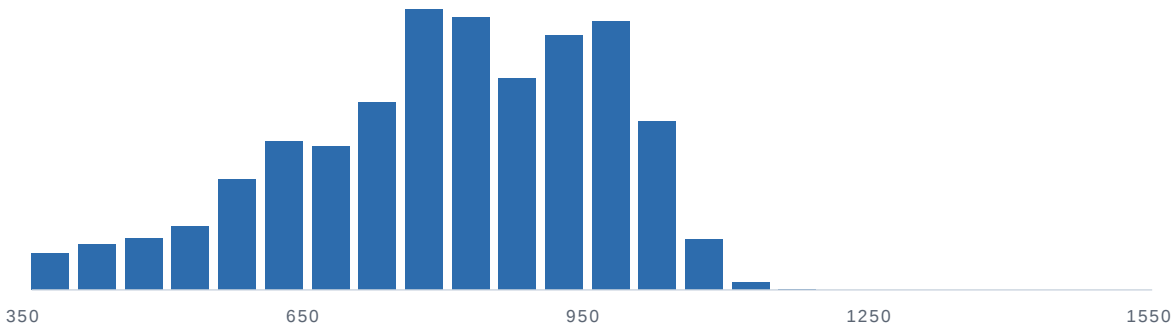
4-1. スプレッド感応度



▲ 実スプレッドが固定1pip想定より広い場合、純益は最大約4割まで目減りします（詳細はライト監査と同じ分析）。

4-2. モンテカルロ・シミュレーション（10万回）

35トレード系列のブートストラップ総損益分布（10万回）



35トレードで損益がマイナスになる確率	0.0%（観測分布のままなら）
総損益の中央値	\$812（5%タイル \$456 / 95%タイル \$1027）

注意：この分布は「観測された2.9%の負け率」をそのまま使うため、左裾を過小評価します。本来のリスクは次の損失率シナリオで測るべきです。

4-3. 損失率シナリオ（非対称構造の脆さの検証）

負け率 2.9%（観測値）	35トレード → +\$791（テスター値どおり）
負け率 10%	期待値 +\$10.4/トレード → 35トレードで約 +\$364
負け率 16.1%	損益分岐（期待値ゼロ）。勝率83.9% = 分岐点
負け率 20%	期待値 -\$6.6/トレード → 35トレードで約 -\$232

観測負け率2.9%は分岐16.1%に対して5.5倍の余裕がありますが、負け率の95%信頼上限は約14.5%（勝率信頼下限の裏返し）で、分岐までの余裕は実質わずかです。スプレッド悪化・レンジ相場化で2～3ポイント勝率が落ちるだけで期待値が消える、繊細な構造です。

5. 総合判定と改善提案

要フォワード（実運用条件での再確認を要する）

数字の粉飾・データ破損はなく、損切り構造は健全。統計的にもテスター上の期待値は有意です。
ただし スプレッド固定1pipは深夜帯で非現実的 約30パラメータ/35トレードの過剰最適化リスク
勝率依存の薄いエッジ 直近1年10ヶ月の無取引期間 —— の4点から、実運用はフォワード確認後を推奨します。

改善提案

エントリー許容スプレッド	MaxSpreadPoints=40（4pipまで許容）→ 10（1pip）へ。深夜帯（02-06時）のエントリーはスプレッド実測後に許可する設計へ
パラメータ削減	H4/D1系・相関ゲートなど無効・低寄与のパラメータ群を削り、有効パラメータを10個程度に。Robustness（分析の頑健性）が向上
フォワード検証	3～6ヶ月のデモ運用で実スプレッド・約定スリッページ・実際の勝率を確認。ライト監査判定と合わせて運用可否を決定
リターン構造	年率約0.8%はリスク1%に対して低い。TP延長（TP_Ratio）や頻度改善で期待値を伸ばす余地を検討

注意事項

本サンプルはテスター報告書1点に基づく統計監査です。実際のフル監査では、.ex4/.mq4から売買ルールを取り出し、実ブローカーのヒストリカルデータ（2015年～）でスプレッド・スリッページ込みの再実行を行います。なお本監査は投資助言ではなく、数字の真偽と構造の検証

結果の報告です。最終的な運用判断はご自身でお願いいたします。

6. 付録：全取引一覧（35件）

#	建玉開始	決済	種別	Lot	エントリー	決済価格	損益(\$)	残高(\$)
1	2017.02.13 03:00	2017.02.13 03:31	buy	0.10	113.905	113.967	5.44	10005.44
3	2017.03.27 02:00	2017.03.27 02:33	sell	0.20	110.561	110.508	9.59	10015.03
5	2017.05.01 09:00	2017.05.02 03:44	buy	0.20	111.741	111.961	39.66	10054.69
7	2017.07.05 11:00	2017.07.05 12:40	buy	0.20	113.492	113.606	20.07	10074.76
9	2017.10.24 18:00	2017.10.25 11:58	buy	0.20	113.954	114.144	33.65	10108.41
11	2017.11.27 15:00	2017.11.27 15:48	sell	0.20	111.036	110.962	13.34	10121.75
13	2018.03.06 14:00	2018.03.07 00:31	buy	0.30	106.361	105.854	-143.15	9978.60
15	2018.03.16 11:00	2018.03.16 13:00	sell	0.30	105.795	105.658	38.90	10017.50
17	2018.05.21 04:00	2018.05.21 06:02	buy	0.40	111.038	111.113	27.00	10044.50
19	2018.07.11 14:00	2018.07.11 18:13	buy	0.40	111.262	111.339	27.66	10072.16
21	2018.09.26 16:00	2018.09.26 18:01	buy	0.60	112.993	113.046	28.13	10100.29
23	2018.10.17 21:00	2018.10.17 21:02	buy	0.50	112.350	112.409	26.24	10126.53
25	2019.01.07 19:00	2019.01.08 05:46	buy	0.30	108.629	108.773	40.26	10166.78
27	2019.06.25 05:00	2019.06.25 06:51	sell	0.30	107.121	106.986	37.86	10204.64
29	2019.08.21 10:00	2019.08.23 10:18	buy	0.40	106.572	106.658	35.12	10239.76
31	2019.11.07 13:00	2019.11.07 17:50	buy	0.30	109.188	109.307	32.66	10272.42
33	2020.01.16 18:00	2020.01.17 01:14	buy	0.50	110.126	110.205	36.74	10309.16
35	2020.01.24 20:00	2020.01.24 20:35	sell	0.50	109.318	109.233	38.91	10348.07
37	2020.03.18 16:00	2020.03.18 16:58	buy	0.10	107.964	108.113	13.78	10361.85
39	2020.06.15 16:00	2020.06.16 05:53	buy	0.40	107.426	107.525	37.55	10399.40
41	2020.10.14 05:00	2020.10.14 15:30	sell	0.50	105.331	105.257	35.15	10434.55
43	2021.04.29 12:00	2021.04.29 16:10	buy	0.30	108.985	109.149	45.08	10479.63
45	2021.05.25 06:00	2021.05.25 09:43	sell	0.60	108.722	108.654	37.55	10517.18
47	2021.07.12 18:00	2021.07.12 18:21	buy	0.50	110.292	110.348	25.37	10542.55
49	2021.10.07 20:00	2021.10.08 03:05	buy	0.40	111.634	111.686	19.34	10561.88
51	2021.10.22 16:00	2021.10.22 17:25	sell	0.40	113.746	113.684	21.81	10583.69
53	2022.02.21 12:00	2022.02.21 20:30	sell	0.40	114.865	114.776	31.02	10614.71
55	2022.08.01 05:00	2022.08.01 10:16	sell	0.10	132.415	132.118	22.48	10637.19
57	2022.12.26 14:00	2022.12.27 11:50	buy	0.30	133.124	133.221	22.38	10659.57
59	2023.01.23 14:00	2023.01.23 15:38	buy	0.10	130.329	130.489	12.26	10671.83
61	2023.03.29 05:00	2023.03.29 05:08	buy	0.20	131.482	131.590	16.41	10688.24
63	2023.09.15 10:00	2023.09.15 10:06	buy	0.30	147.621	147.706	17.26	10705.50
65	2024.02.22 15:00	2024.02.22 15:30	buy	0.50	150.415	150.470	18.28	10723.78
67	2024.09.27 03:00	2024.09.27 03:38	buy	0.20	145.071	145.310	32.90	10756.68
69	2024.10.11 17:00	2024.10.14 02:00	buy	0.20	149.083	149.339	34.64	10791.32